



东兴期货
DONGXING FUTURES

期货晨报

期货研究报告

2019年8月14日

投资咨询部

一、隔夜基差表

东兴期货 投资咨询部 DONGXING FUTURES		隔夜基差表						
日期	品种	现货	合约	合约价格	隔夜涨跌幅	期货升贴水	升贴水变化	注:
2019/08/13	IF	3665.8	IF1908	3652.2	-0.56%	-13.55	贴水缩窄	现货价格: 沪深300指数
			IF1909	3633.6	-0.49%	-32.15	贴水缩窄	
2019/08/13	IC	4658.4	IC1908	4646.8	-0.41%	-11.59	贴水缩窄	现货价格: 中证500指数
			IC1909	4584.8	-0.54%	-73.59	贴水缩窄	
2019/08/13	IH	2792.9	IH1908	2785.2	-0.65%	-7.71	贴水缩窄	现货价格: 上证50指数
			IH1909	2770	-0.61%	-22.91	贴水缩窄	
2019/08/13	TS	2.7207	TS1909	100.46	0.01%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS1912	100.325	0.04%	-	-	
2019/08/13	TF	2.9011	TF1909	100.3	0.03%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF1912	100.14	0.11%	-	-	
2019/08/13	T	3.0041	T1909	99.345	0.13%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T1912	99.02	0.20%	-	-	
2019/08/12	铁矿	793.86	I1909	711.5	-2.20%	-82.36	贴水缩窄	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I2001	627.5	-1.72%	-166.36	贴水缩窄	
2019/08/13	螺纹	3814	RB1910	3677	0.00%	-137.43	贴水扩大	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB2001	3440	-0.32%	-374.43	贴水扩大	
2019/08/13	LLDPE	7550	L1909	7545	-0.13%	-5.00	贴水扩大	完税自提价(低端价): 线型低密度聚乙烯LLDPE(膜级): 上海
			L2001	7585	0.07%	35.00	升水扩大	
2019/08/13	PP	8650	PP1909	8538	0.07%	-112.00	贴水缩窄	市场价(现货基准价): PP粒(T30S): 余姚
			PP2001	8150	-0.22%	-500.00	贴水缩窄	
2019/08/13	棕榈油	4730	P1909	4722	1.24%	-8.00	贴水缩窄	交货价: 棕榈油: 天津港/宁波港/黄埔港扣除升贴水后最低价
			P2001	4862	0.66%	132.00	升水扩大	
2019/08/13	焦煤	1710	JM1909	1414	0.35%	-296.00	贴水缩窄	京唐港: 库提价(含税): 主焦煤(A10%, V24%, <0.8%S, G80): 河北产
			JM2001	1328	-0.52%	-382.00	贴水扩大	
2019/08/13	焦炭	2247	J1909	2053	-0.34%	-194.31	贴水扩大	天津港: 平仓价(含税): 一级冶金焦(A<12.5%, <0.65%S, CSR>65%, Mt8%): 山西产, 水分折算后
			J2001	1984	-1.24%	-263.31	贴水扩大	
2019/08/13	动力煤	581	ZC909	573.2	-0.90%	-7.80	贴水扩大	市场价: 动力煤(Q5500, 山西产): 秦皇岛
			ZC001	565	-1.26%	-16.00	贴水扩大	
2019/08/13	PTA	5185	TA909	5232	0.27%	47.00	升水缩窄	PTA: CCFEI价格指数: 精对苯二甲酸PTA内盘
			TA001	5154	-0.08%	-31.00	升水缩窄	
2019/08/13	MA	2115	MA909	2146	0.56%	31.00	升水缩窄	MA: 市场估价(中间价): 甲醇: 江苏出罐
			MA001	2274	0.75%	159.00	升水扩大	
2019/08/13	橡胶	10300	RU1910	10440	-1.51%	140.00	升水缩窄	市场价: 天然橡胶: 云南国营全乳胶(SCR5): 上海
			RU2001	11360	-1.13%	1060.00	升水缩窄	
2019/08/13	豆油	6000	Y1909	6096	0.93%	96.00	升水扩大	现货价: 四级豆油: 大连
			Y2001	6206	0.75%	206.00	升水扩大	
2019/08/13	豆粕	3050	M1909	2948	1.62%	-102.00	贴水扩大	现货价: 豆粕: 大连
			M1909	2948	1.62%	-102.00	贴水扩大	
2019/08/13	菜油	7400	O1909	7288	1.11%	-112.00	贴水缩窄	现货价: 菜油: 安徽
			O1001	7379	1.29%	-21.00	贴水缩窄	
2019/08/13	菜粕	2457	RM909	2519	1.21%	62.33	升水扩大	现货价: 平均价: 菜粕
			RM001	2375	2.06%	-81.67	贴水缩窄	

免责声明: 我公司对本表中信息和数据的准确性及完整性不作任何保证。在任何情况下, 表格中的信息或所表达的意见并不构成所述品种买卖的出价或询价。

二、各品种基本面指标

 东兴期货 投资咨询部		2019/8/14		宏观基本面指标变化	
资金变动		隔夜	前一日	变化幅度	
	两市融资余额（亿元）	8940.7500	8925.9900	14.7600	
	沪股通净流入（亿元）	-17.8220	3.0151	-20.8371	
	深股通净流入（亿元）	-6.5389	19.3766	-25.9155	
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	2.7545	2.6978	0.0567	
	银行间质押式回购（7天）	2.9364	2.7632	0.1732	
	Shibor（1天）	2.6670	2.6290	0.0380	
	Shibor（7天）	2.7030	2.6560	0.0470	
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.9900	2.8500	0.1400	
	深市质押式回购	2.7300	2.7000	0.0300	
期指操作建议	今日公布7月经济运行数据，昨夜美国表示推迟对中国部分产品征收关税，美股大幅收涨，期指IC多单谨持，本周期指交割，注意移仓。				
农产品操作建议	郑糖短期震荡偏强运行趋势预计将反复，但上方压力明显，警惕回调风险，建议以日内短线操作为主，可适当逢高做空，SR2001关注5520元/吨附近支撑。				
备注：两融余额由于更新时间影响，采用前日数据代替隔夜数据。					

免责声明：本报告中的信息均来源于已公开的资料，我公司对这些信息的准确性及完整性不作任何保证，不保证该信息未经任何更新，也不保证本公司做出的任何建议不会发生任何变更。在任何情况下，报告中的信息或所表达的意见并不构成所述品种买卖的出价或询价。本报告版权归东兴期货投资咨询部所有。未获得东兴期货投资咨询部书面授权，任何人不得对本报告进行任何形式的发布、复制。如引用、刊发，需注明出处为“东兴期货投资咨询部”，且不得对本报告进行有悖原意的删节和修改。